

Berechnung CVA



Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
 Währung: EUR
 ISIN: DE000A2H7NU1
 LEI: 529900Q626RC55DLB570
 Fondsvermögen: 304.373.524,51
 Anteile in Umlauf: 3.542.688

Auswertung per: 20.4.2026 23:45
 Bewertungsdatum: 20.4.2026 23:45

Kontrahent ID	Kontrahent	Kontrahent-LEI	KSA Bonitätsstufe Kontrahent	Risikogewicht je Kontrahent (RW)	Standard CVA-Risiko SCVA	Term 1 Fonds (Zwischenergebnis)	Term 2 Fonds (Zwischenergebnis)	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
871001	BNP Paribas S.A.	ROMUWSFPU8MPRO8K5F	2	5,00	9.817,98	1.516.529.107,68	3.547.161.915,13	46.253,75	46.253,75	0,02	0
805250	J.P. Morgan SE	549300ZK53CNGEEI6A29	1	5,00	68.067,29	1.516.529.107,68	3.547.161.915,13	46.253,75	46.253,75	0,02	0
Total								46.253,75	46.253,75	0,02	
									davon OTC:		
									2.070.863,31	0,68	

Fondsvolumen inkl. Forderungen 304.373.524,51
 - Fondsvolumen aus Bewertung 304.373.524,51
 Differenz -0,00

	304.373.524,51	Default: Fondsvolumen aus Bewertung --> mit Buchwert überschreiben
	Betrag in Buchwert:	
	46.252,60	
	2.070.863,10	
	442.355,17	
	17.303.984,90	
ZUSATZINFORMATIONEN:		
CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,02 Zeile 20; Spalte 70	
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,68 Zeile 20; Spalte 10	
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,15 Zeile 20; Spalte 20	
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	5,69 Zeile 20; Spalte 30	
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70	
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10	
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20	
CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	0,00 Zeile 130; Spalte 70	
Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 130; Spalte 10	
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00 Zeile 130; Spalte 20	
Aggregation systematischer Komponenten des CVA-Risikos	0,03 Zeile 230; Spalte 70	77.886,14
Aggregation spezifischer Komponenten des CVA-Risikos	0,02 Zeile 240; Spalte 70	68.773,20